海富通安颐收益混合型证券投资基金
2024 年年度报告
2024 年 12 月 31 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年三月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
§2 基金简介 6
2.1 基金基本情况 6
2.2 基金产品说明 6
2.3 基金管理人和基金托管人 7
2.4 信息披露方式 7
2.5 其他相关资料 7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 8
3.1 主要会计数据和财务指标 8
3.2 基金净值表现 10
3.3 过去三年基金的利润分配情况 13
§4 管理人报告 13
4.1 基金管理人及基金经理情况 13
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 19
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 20
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 21
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 22
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 23
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 24
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 24
§5 托管人报告 24
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 24
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 24
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 24
§6 审计报告 25
6.1 审计意见 25
6.2 形成审计意见的基础 25
6.3 其他信息 25
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任 26
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任 26
§7 年度财务报表 27
7.1 资产负债表 27
7.2 利润表 28
7.3 净资产变动表 30
7.4 报表附注 31
§8 投资组合报告 62
8.1 期末基金资产组合情况 62
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 63
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 71

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 72
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 73
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 73
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 73
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 73
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 73
8.12 投资组合报告附注 74
§9 基金份额持有人信息 75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 75
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 75
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 76
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 76
§10 开放式基金份额变动 76
§11 重大事件揭示 77
11.1 基金份额持有人大会决议 77
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 77
11.4 基金投资策略的改变 77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 77
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 77
11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 77
11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 78
11.8 其他重大事件 79
12 影响投资者决策的其他重要信息 80
§13 备查文件目录 82
13.1 备查文件目录 82
13.2 存放地点 82
13.3 查阅方式 82

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通安颐收益混合型证券投资基金	
基金简称	海富通安颐收益混合	
基金主代码	519050	
交易代码	519050	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 5 月 29 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	82,675,148.27 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C
下属分级基金的交易代码	519050	002339
报告期末下属分级基金的份额总额	68,703,512.18 份	13,971,636.09 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金坚持灵活的资产配置，在严格控制下跌风险的基础上，积极把握股票市场的投资机会，确保资产的保值增值，实现战胜绝对收益基准的目标，为投资者提供稳健的养老理财工具。
投资策略	本基金的资产配置策略以基金的投资目标为中心，在实现既定的投资目标同时将可能的损失最小化。首先按照投资时钟理论，根据宏观预期环境判断经济周期所处的阶段，作出权益类资产的初步配置，并根据投资时钟判断大致的行业配置；其次结合证券市场趋势指标，判断证券市场指数的大致风险收益比，从而做出权益类资产的具体仓位选择。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于

	中等风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	岳冲	许俊
	联系电话	021-38650788	010-66596688
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号18层1802-1803室以及19层1901-1908室	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号18层1802-1803室以及19层1901-1908室	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		路颖	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年		2023 年		2022 年	
	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C
本期已实现收益	2,301,036.62	460,395.74	-1,363,629.35	-302,858.41	-770,249.20	34,135.27
本期利润	5,008,472.05	1,050,779.62	222,865.63	312,997.17	-21,788,089.86	-29,309,078.15
加权平均基金份额本期利润	0.0614	0.0589	0.0020	0.0085	-0.1034	-0.0987
本期加权平均净值利润率	4.95%	4.67%	0.16%	0.67%	-7.89%	-7.35%
本期基金份额净值增长率	5.29%	5.18%	-0.45%	-0.54%	-6.23%	-6.33%
3.1.2 期末数据和指标	**2024 年末**		**2023 年末**		**2022 年末**	
	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C

期末可供分配利润	12,008,497.04	2,720,868.00	13,462,748.91	3,546,650.19	22,267,423.68	10,025,811.31
期末可供分配基金份额利润	0.1748	0.1947	0.1429	0.1635	0.1583	0.1805
期末基金资产净值	88,187,868.08	18,239,219.41	114,870,629.60	26,914,146.97	172,219,107.23	69,300,965.58
期末基金份额净值	1.2836	1.3054	1.2191	1.2411	1.2246	1.2479
3.1.3 累计期末指标	**2024 年末**		**2023 年末**		**2022 年末**	
	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C
基金份额累计净值增长率	98.41%	49.76%	88.44%	42.39%	89.29%	43.17%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金自 2016 年 1 月 8 日起，根据收费模式的不同，将基金分为海富通安颐收益混合 A（原海富通养老收益混合 A）和海富通安颐收益混合 C（原海富通养老收益混

合 C）两类份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1．海富通安颐收益混合 A：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.28%	0.45%	1.18%	0.01%	0.10%	0.44%
过去六个月	2.70%	0.39%	2.37%	0.01%	0.33%	0.38%
过去一年	5.29%	0.36%	4.76%	0.01%	0.53%	0.35%
过去三年	-1.72%	0.29%	14.95%	0.01%	-16.67%	0.28%
过去五年	16.00%	0.28%	26.15%	0.01%	-10.15%	0.27%
自基金合同生效起至今	98.41%	0.36%	76.25%	0.02%	22.16%	0.34%

2．海富通安颐收益混合 C：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.25%	0.45%	1.18%	0.01%	0.07%	0.44%
过去六个月	2.65%	0.39%	2.37%	0.01%	0.28%	0.38%
过去一年	5.18%	0.36%	4.76%	0.01%	0.42%	0.35%
过去三年	-2.02%	0.29%	14.95%	0.01%	-16.97%	0.28%
过去五年	15.42%	0.28%	26.15%	0.01%	-10.73%	0.27%
自基金合同生效起至今	49.76%	0.26%	51.76%	0.01%	-2.00%	0.25%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通安颐收益混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

1．海富通安颐收益混合 A

(2013 年 5 月 29 日至 2024 年 12 月 31 日)

2．海富通安颐收益混合 C

(2016 年 1 月 8 日至 2024 年 12 月 31 日)

注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定

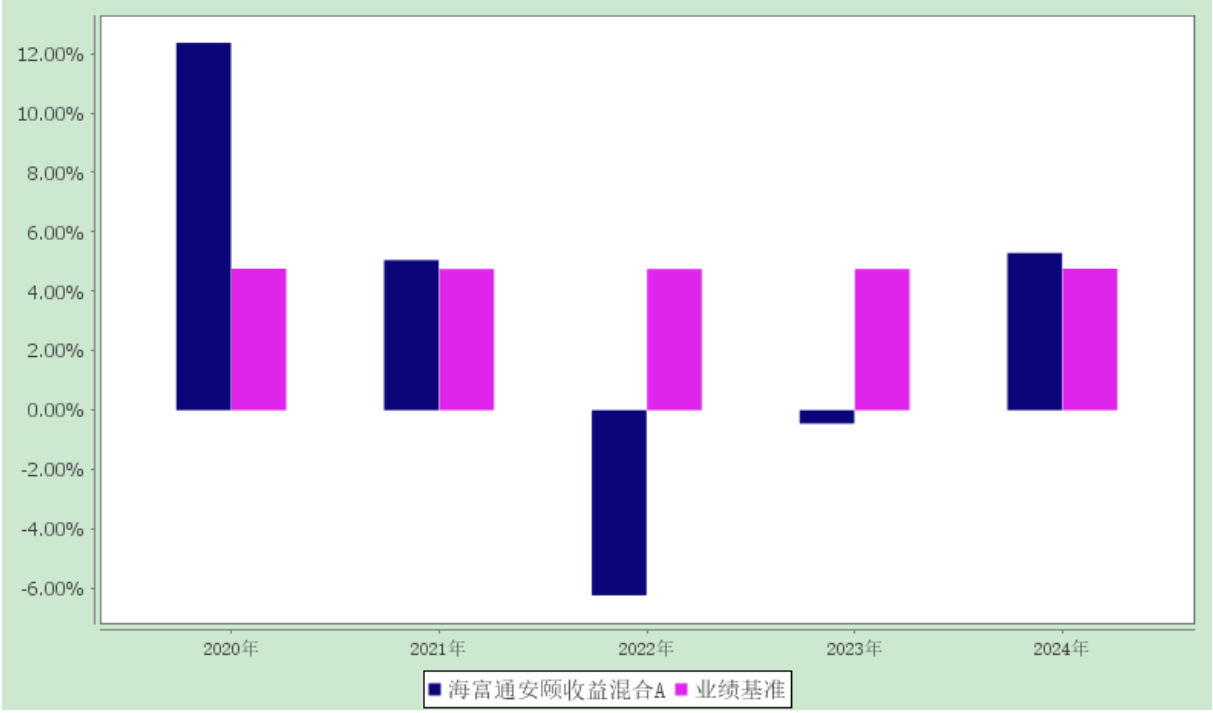
的各项比例。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

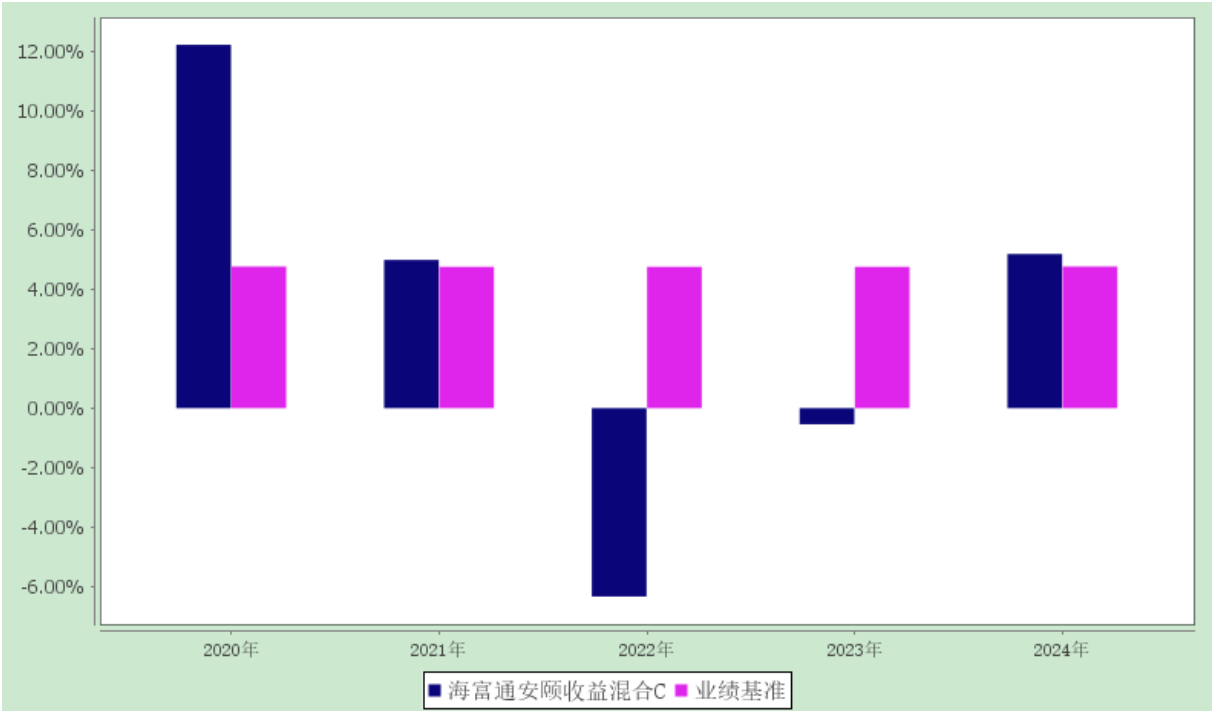
海富通安颐收益混合型证券投资基金

过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

1．海富通安颐收益混合 A



2．海富通安颐收益混合 C



3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、海富通安颐收益混合 A：

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	0.780	12,249,825.64	2,473,989.95	14,723,815.59	-
合计	0.780	12,249,825.64	2,473,989.95	14,723,815.59	-

2、海富通安颐收益混合 C：

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	0.780	22,368,415.24	553,774.66	22,922,189.90	-
合计	0.780	22,368,415.24	553,774.66	22,922,189.90	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2024 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 97 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、

海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 A100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化前锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通惠睿精选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券投资基金、海富通

成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通恒益金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通盈丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金、海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金、海富通产业优选混合型证券投资基金、海富通瑞鑫 30 天持有期债券型证券投资基金、海富通优势驱动混合型证券投资基金、海富通 ESG 领先股票型证券投资基金、海富通中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金、海富通红利优选混合型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、海富通数字经济混合型证券投资基金、海富通量化选股混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
夏妍妍	本基金的基金经理	2019-05-22	2024-03-22	9 年	上海交通大学经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任西门子金融服务集团西门子管理培训生，西门子财务租赁有限公司上海分公司高级财务分析师，2014 年加入海富通基金管理有限公司，历任固定收益投资部固定收益分析师、基金经理助理。2018 年 1 月至 2023 年 1 月任海富通欣益混合基金经理。2018 年 4 月至 2024 年 3 月兼任海富通一年定期开放债券基金经理。2018 年 4 月至 2021 年 5 月任海富通融丰定开债券基金经理。2019 年 5 月至 2024 年 3 月兼任海富通安颐收益混合基金经理。2019 年 10 月至 2020 年 11 月兼任海富通瑞丰债券基金经理。2019 年 10 月至 2021 年 9 月兼任海富通瑞合纯债基金经理。2019 年 10 月至 2023 年 4 月兼任海富通富祥混合基金经

					理。2019 年 10 月至 2024 年 3 月兼任海富通聚合纯债基金经理。2020 年 5 月至 2023 年 10 月兼任海富通富盈混合基金经理。2021 年 5 月至 2024 年 3 月兼任海富通美元债（QDII）基金经理。2021 年 8 月至 2024 年 3 月兼任海富通瑞兴 3 个月定开债券基金经理。2022 年 7 月至 2024 年 3 月兼任海富通策略收益债券基金经理。
谈云飞	本基金的基金经理	2024-03-21	-	19 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 4 月至 2014 年 6 月就职于华宝兴业基金管理有限公司，曾任产品经理、研究员、专户投资经理、基金经理助理，2014 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2014 年 7 月至 2015 年 10 月任海富通现金管理货币基金经理。2014 年 9 月至 2020 年 9 月任海富通季季增利理财债券基金经理。2015 年 1 月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。2015 年 4 月至 2020 年 1 月兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 2 月起兼任海富通货币基金经理。2016 年 4 月至 2017 年 6 月兼任海富通纯债债券、海富通双福债券（原海富通双福分级债券）、海富通双利债券基金经理。2016 年 4 月至 2020 年 1 月兼任海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016 年 9 月至 2023 年 7 月兼任海富通聚利债券基金经理。2016 年 9 月至 2020 年 1 月兼任海富通欣荣混合基

					金经理。2016 年 9 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合基金经理。2017 年 2 月至 2021 年 10 月兼任海富通强化回报混合基金经理。2017 年 3 月起兼任海富通欣享混合基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 7 月至 2020 年 9 月任海富通季季通利理财债券基金经理。2019 年 9 月至 2023 年 1 月兼任海富通中短债债券基金经理。2021 年 2 月起兼任海富通惠睿精选混合基金经理。2022 年 3 月至 2023 年 9 月兼任海富通欣润混合基金经理。2022 年 3 月至 2023 年 5 月兼任海富通惠鑫混合基金经理。2022 年 5 月起兼任海富通恒益一年定开债券发起式基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通安颐收益混合基金经理。
杜晓海	本基金的基金经理；总经理助理。	2016-06-22	-	24 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监、量化投资部总监，现任海富通基金管理有限公司总经理助理。2016 年 6 月起任海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年

					9 月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 10 月兼任海富通富睿混合（现海富通沪深 300 增强）基金经理。2018 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 10 月兼任海富通量化前锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月至 2022 年 8 月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月至 2021 年 7 月兼任海富通中证 500 增强（原海富通中证内地低碳指数）基金经理。2020 年 4 月至 2021 年 7 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 5 月至 2023 年 10 月兼任海富通富盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月至 2024 年 9 月兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。2023 年 10 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。2024 年 3 月起兼任海

					富通 ESG 领先股票基金经理。2024 年 6 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 发起联接基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
杜晓海	公募基金	8	1,699,854,288.77	2016/06/22
	私募资产管理计划	2	395,716,104.78	2024/11/18
	其他组合	1	273,254,028.49	2021/06/28
	合计	11	2,368,824,422.04	-

注：表内任职日期为基金经理加入公司以来首次开始管理各类产品的时间。

4.1.4 基金经理薪酬机制

基金经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现直接挂钩的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了一级市场和二级市场的所有投资交易管理活动以及公司内部的证券分配，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异

进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95%置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本基金的投资运作符合法律法规和基金合同的规定，未发生内幕交易、操纵市场、不当关联交易以及其他损害委托人利益的违规行为。本基金与本基金管理人所管理的其他资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待、独立运作。本基金的基金经理同时兼任私募资产管理计划的投资经理，公司根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》的要求，对相关基金经理的同反向交易、交易价差等加强了管理、监控和分析。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年，国内经济整体维持弱修复状态，实际 GDP 同比实现 5%增长，高于 2022-2023 年的复合增速 4.3%。物价也保持相对平稳，全年居民消费价格指数同比上涨 0.2%。从节奏上看，年初经济实现开门红，二季度经济增长开始放缓。但是，随着 9 月 24 日以来一系列宏观政策持续加码，市场信心开始回暖，房地产成交显著放量，居民消费开始好转，股市也震荡走强，最终四季度实际 GDP 实现了 5.4%的增长。

海外经济方面，2024 年美国积极的财政和宽松的货币政策共同支撑其国内经济。随着美国通胀开始降温，9 月美联储启动了降息，年内累计降息 100BP，2024 年财年财政赤字率达到了 6.6%，高于 2023 年的 6.2%。在宽松货币政策和积极财政政策下，短期美国经济还难言衰退。此外，特朗普赢得了美国总统大选，需要关注未来中美关系及特朗普对华政策变化。

从 A 股市场看，全年市场震荡走高。2024 年，上证指数涨幅为 12.7%，沪深 300 为 14.7%，中证 800 为 12.2%。其中，924 以来中小成长风格弹性更大，创业板指涨幅为 39.9%，中证 1000 为 33.3%，中证 800 为 23.7%。本报告期内，从行业维度上看，价值板块和成长板块阶段性都有不错的表现，整体来看，以红利为代表的价值板块相对占优。全年来看，大市值股票跑赢小市值股票。以食品饮料、医药为代表的消费板块和地产链板块全年表现较弱，受益于 AI 技术进步的通信、电子板块表现亮眼；红利板块全

年表现较为稳健。

在宏观经济缓慢复苏、市场情绪回暖的背景下，本基金保持多头思维，积极配置拥挤度较低、盈利有预期改善的高性价比资产，组合风格向均衡结构靠拢，同时在因子配置上尽可能兼顾估值与成长，同时适当暴露价量因子。本基金的投资思路为在控制风险的基础上，积极地捕捉市场的结构性机会，力争获取绝对收益。

固定收益方面，2024 年国内经济企稳，实际 GDP 增速达到 5%。整体来看，生产端修复节奏好于需求端，制造业 PMI 在四季度维持在扩张区间。投资端方面，制造业与基建投资实现高增，地产投资惯性下滑。消费增速在国家补贴、消费券政策的支撑下有一定幅度的回暖。出口方面，海外需求不弱，贸易顺差维持在高位。通胀方面，CPI 总体弹性有限，年初转正后维持在 1%以下；PPI 在基数效应下跌幅收窄但仍未转正。货币政策方面态度积极，年内两次降准共 100bp；7 天逆回购利率调降 2 次共 30bp；MLF 利率调降 2 次共 50bp；1 年期与 5 年期 LPR 利率调降 2 次共 35bp。除此之外央行通过公开市场买断式逆回购、国债净买入操作投放流动性。财政政策方面同样积极，上半年超长期特别国债落地，2024 年率先发行 1 万亿；下半年新增 2 万亿专项债额度用于化解地方隐性债务。流动性方面总体维持合理充裕的状态，但分层的现象较为突出。资金价格方面，2024 年 R001 与 R007 均值为 1.77%和 1.96%。对应债市而言，2024 年走出牛市行情，货币政策宽松成为主导。除了在 8 月央行提示债券市场风险、9 月末权益市场火热导致债券市场出现阶段性调整外，其余时间收益率均处于下行趋势。其中收益率下行最快的时间在年末时点，12 月政治局会议与中央经济工作会议打下 2025 年货币政策维持宽松的基础，市场出现一定的抢跑行情。全年来看，10 年期国债到期收益率累计下行 88bp。

本基金债券部分全年以信用债为主要配置。信用债品种上，选择中高等级、中等期限的信用债，在收益率大幅下行、信用利差被大幅压缩后，提高利率债配置比例，并积极进行利率债交易，提高组合久期，获得较好的绝对回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通安颐收益混合 A 净值增长率为 5.29%，同期业绩比较基准收益率为 4.76%。海富通安颐收益混合 C 净值增长率为 5.18%，同期业绩比较基准收益率为 4.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从全球经济看，2025 年美国财政刺激力度依然不弱，叠加降息周期还没结束，居民和企业部门资产负债表相对健康，短期美国经济还难言衰退。不过，随着特朗普关税、移民、减税等政策落地，美国通胀压力可能会抬升，美联储的降息节奏和幅度可能还存在变数，经济也存在滞胀风险。同时，美国债务上限问题依旧困扰财政政策，下半年国债发行冲击可能导致美债收益率冲高，这对全球金融市场、各类资产都将产生较为显著

的影响，未来需要密切跟踪。

从市场方向看，当前中国经济持续修复，随着 924 以来一系列政策出台，官方积极回应市场的关切，市场信心已较大改善，上证指数震荡走高，2024 年第 4 季度 GDP 增速也超预期增长，相关政策对经济有提振作用。在最新中央经济工作会议中，提出了“稳住楼市股市”、“创新金融工具，维护金融市场稳定”等，我们认为国内资本市场风险可控、积极可为。展望未来，我们对 A 股充满信心，将积极跟踪国内政策和经济的变化，把握投资机会。

投资策略上，我们将利用选股因子和组合优化模型，兼顾估值、盈利质量、景气度的匹配度，寻找各板块内低估值的优质股票投资机会，以赚取绝对收益。我们将重点关注估值合理、基本面有积极变化的个股，同时密切跟踪前期超额较高的个股，适时做出止盈。本基金也将利用动态的仓位调整或者股指期货套保等风险管理工具来控制回撤风险。

固定收益方面，展望 2025 年，经济或企稳。投资方面，在财政政策维持宽松的情况下有望保持偏高的景气度；制造业投资在高技术领域将继续发力；地产投资跌幅有望收窄。通胀方面，CPI 有望维持在正增区间，PPI 跌幅有望收窄。货币政策方面，预计基础货币投放方式将会更加多元，降准降息仍有空间。财政政策或仍有加码，提高财政赤字、增加专项债额度、增发特别国债等均可能落地。

2025 年对债券市场中性偏乐观。从开年的情况来看，货币政策方面央行在公开市场流动性投放方面呈现净回笼的状态，叠加一季度经济仍处在 2024 年末政策的红利期，在资金利率持续偏高的背景下，短端利率与长端利率均出现了不同幅度的调整。但站在中期角度来看，2025 年政府工作报告中依然提出“实施适度宽松的货币政策，适时降准降息”，此外考虑到经济基本面修复的过程中还会面临外部冲击的压力，经济基本面弱改善意味着货币政策后续仍有空间，债券市场仍有配置价值。

本基金债券部分在 2025 年将继续保持一定的信用债配置，同时用利率债进行交易和久期管理，争取获得较好的绝对回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2024 年，基金管理人监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，通过业务审核、合规检查、系统监控、重点抽查、专项审计等一系列方式开展工作，强化基金运作和公司运营的合规性，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报董事会和公司管理层。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、加强合规管理，持续完善公司的规章制度体系

报告期内，坚持以法律法规和公司制度为依据，对公司和基金运作的各项业务开展提供全面的合规咨询、审核、监测与检查，确保基金运作的合法合规性。根据法律法规、监管政策的变化，结合业务发展及公司管理需要，对公司内控制度体系进行了完善和全

面梳理，新增和修订了多项内部制度和流程，提升了公司的合规管理水平。

二、客观开展内外部内控评估，进一步优化内控措施

根据法规、监管要求并结合风险导向和全覆盖原则，公司继续通过日常业务的定期合规检查、不定期自查等方式，重点关注规章制度的执行情况、第一道防线风险控制的有效性和投资运作与产品合同约定的一致性。同时，对各部门的业务有重点的开展了多项专项检查和内部审计。另外，根据法规和公司管理需要，公司聘请会计师事务所等外部专业机构对公司开展了内部控制评价等方面的审计。通过内外部审计及合规检查，审视法律法规和监管要求的落实情况、监督公司制度流程的执行情况，及时发现存在的问题，并通过加强跨部门的协作沟通，形成合力，认真整改，进一步健全完善了公司的内部控制体系。

三、有效推进反洗钱与反恐怖融资工作

报告期内，结合反洗钱法规及公司业务特点完善了反洗钱制度，组织多场反洗钱培训和宣传活动；基于风险为本的工作思路，继续开展客户信息数据治理工作，稳步推进代销机构分类管理工作，持续优化监测模型，强化可疑交易监控，并按时向中国反洗钱监测分析中心报送相关数据。报告期内，公司根据监管要求完成了各项洗钱固有风险评估及洗钱风险控制措施有效性调查工作，有效管控公司洗钱固有风险敞口。另外，公司加大反洗钱课题研习工作力度，组织反洗钱专兼职人员深入开展相关课题研究和投稿，提升反洗钱工作质效。

四、强化合规文化培训，提升员工的合规及风险意识

本报告期内，为提高公司全员的合规意识，加大了合规培训力度，强化主动合规意识培育。公司进一步加强组织各类合规培训频率，及时对法规、监管精神和公司要求进行宣导，并通过制作合规法务月刊、开展“合规文化宣传月”主题活动等多样化的合规宣传培训方式进一步提高法律法规宣导工作的及时性，丰富合规宣导工作的形式，激发全体员工学习合规内控政策的积极性，营造合规文化浓厚氛围。通过培训，增强了全体员工的合规意识和风险防范意识，提升了员工的主动识别和控制业务风险的积极性和能力。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金财产安全、合规、诚信运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括分管基金运营业务的高级管理人员、

分管投资业务的高级管理人员、督察稽核部负责人、风险管理部负责人、研究部负责人及基金运营部负责人等，以上人员具有丰富的合规、风控、证券研究、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会对经济环境发生重大变化或发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金运营部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%。

本基金本报告期内未实施利润分配，但符合基金合同规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对海富通安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益混合型证券投资基金）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“ 关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

毕马威华振审字第 2502207 号

海富通安颐收益混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了后附的海富通安颐收益混合型证券投资基金 (以下简称“该基金”) 财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表、2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

该基金管理人海富通基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。

该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3)评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4)对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大

不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。

(5)评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）　　中国注册会计师

虞京京　何晨

北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

2025 年 3 月 27 日

§7　年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海富通安颐收益混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资　产：			
货币资金	7.4.7.1	4,577,019.08	3,432,439.45
结算备付金		2,533,647.63	7,355,366.93
存出保证金		11,955.18	11,151.92
交易性金融资产	7.4.7.2	106,841,457.84	152,129,482.21
其中：股票投资		29,036,662.25	37,318,153.73
基金投资		-	-
债券投资		77,804,795.59	114,811,328.48
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		44,015.19	31,442.08
应收股利		-	-
应收申购款		36,238.01	44,183.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		114,044,332.93	163,004,066.57
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2024 年 12 月 31 日**	**上年度末 2023 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		6,999,546.33	19,597,677.37
应付清算款		907.35	783,821.50
应付赎回款		308,327.90	441,184.79
应付管理人报酬		91,407.35	121,812.85
应付托管费		18,281.46	24,362.57
应付销售服务费		1,570.53	2,303.28
应付投资顾问费		-	-
应交税费		889.72	3,117.86
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	196,314.80	245,009.78
负债合计		7,617,245.44	21,219,290.00
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	82,675,148.27	115,909,840.53
未分配利润	7.4.7.8	23,751,939.22	25,874,936.04
净资产合计		106,427,087.49	141,784,776.57
负债和净资产总计		114,044,332.93	163,004,066.57

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.2836 元，C 类基金份额净值 1.3054 元。基金份额总额 82,675,148.27 份，其中 A 类基金份额 68,703,512.18 份，C 类基金份额 13,971,636.09 份。

7.2 利润表

会计主体：海富通安颐收益混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间

		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	**2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日**
一、营业总收入		7,918,900.80	3,348,096.28
1.利息收入		107,330.41	230,964.82
其中：存款利息收入	7.4.7.9	98,626.11	168,356.95
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,704.30	62,607.87
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,507,884.18	893,006.09
其中：股票投资收益	7.4.7.10	346,601.78	-4,600,114.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	3,122,712.53	3,861,612.09
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.12	-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	242,530.79	662,469.63
股利收益	7.4.7.14	796,039.08	969,039.12
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	3,297,819.31	2,202,350.56
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	5,866.90	21,774.81
减：二、营业总支出		1,859,649.13	2,812,233.48
1．管理人报酬		1,238,524.36	1,869,320.40
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2．托管费		247,704.77	440,070.63
3．销售服务费		22,537.51	46,953.91
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		139,818.16	226,004.85
其中：卖出回购金融资产支出		139,818.16	226,004.85
6. 信用减值损失		-	-
7．税金及附加		4,752.37	8,879.59
8．其他费用	7.4.7.17	206,311.96	221,004.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**6,059,251.67**	**535,862.80**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**6,059,251.67**	**535,862.80**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,059,251.67	535,862.80

7.3 净资产变动表

会计主体：海富通安颐收益混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	115,909,840.53	-	25,874,936.04	141,784,776.57
二、本期期初净资产	115,909,840.53	-	25,874,936.04	141,784,776.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-33,234,692.26	-	-2,122,996.82	-35,357,689.08
（一）、综合收益总额	-	-	6,059,251.67	6,059,251.67
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-33,234,692.26	-	-8,182,248.49	-41,416,940.75
其中：1.基金申购款	2,847,793.39	-	715,237.88	3,563,031.27
2.基金赎回款	-36,082,485.65	-	-8,897,486.37	-44,979,972.02
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	82,675,148.27	-	23,751,939.22	106,427,087.49
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合	未分配利润	净资产合计

		收益		
一、上期期末净资产	196,168,587.88	-	45,351,484.93	241,520,072.81
二、本期期初净资产	196,168,587.88	-	45,351,484.93	241,520,072.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-80,258,747.35	-	-19,476,548.89	-99,735,296.24
（一）、综合收益总额	-	-	535,862.80	535,862.80
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-80,258,747.35	-	-20,012,411.69	-100,271,159.04
其中：1.基金申购款	6,206,156.83	-	1,535,385.67	7,741,542.50
2.基金赎回款	-86,464,904.18	-	-21,547,797.36	-108,012,701.54
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	115,909,840.53	-	25,874,936.04	141,784,776.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：任志强，主管会计工作负责人：胡光涛，会计机构负责人：胡正万

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

海富通安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益混合型证券投资基金）(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]299 号文核准，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通养老收益混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开

放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 850,131,326.99 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 328 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通养老收益混合型证券投资基金基金合同》于 2013 年 5 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 850,399,612.86 份基金份额,其中认购资金利息折合 268,285.87 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据本基金管理人海富通基金管理有限公司 2016 年 1 月 6 日《关于海富通养老收益混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》的规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2016 年 1 月 8 日起对本基金增加 C 类份额并相应修改基金合同。本基金原有的基金份额类别更名为 A 类基金份额，新增的基金份额类别命名为 C 类基金份额，并对 C 级份额收取销售服务费。

根据本基金管理人海富通基金管理有限公司 2018 年 6 月 1 日《海富通基金管理有限公司关于海富通养老收益混合型证券投资基金更名的公告》，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2018 年 6 月 1 日起，海富通养老收益混合型证券投资基金更名为海富通安颐收益混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通安颐收益混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包含国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、可转换债券、分离交易可转换债券、次级债券、中小企业私募债券、债券回购、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。在正常市场情况下，本基金投资组合的比例范围为：本基金股票投资及存托凭证占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，债券、银行存款、货币市场工具、现金及其它资产合计占基金资产的比例为 5%-100%，其中每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率(税后)+ 2%。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2025 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况、2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a)金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、资产支持证券投资、衍生工具等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特

定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b)金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a)金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b)后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c)金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或

- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新

计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

-本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。 经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

(d)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(e)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	4,577,019.08	3,432,439.45
等于：本金	4,576,540.69	3,432,132.11
加：应计利息	478.39	307.34
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-

存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	4,577,019.08	3,432,439.45

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		28,250,672.14	-	29,036,662.25	785,990.11
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	33,090,364.04	247,785.66	34,499,160.86	1,161,011.16
	银行间市场	41,435,487.52	385,184.73	43,305,634.73	1,484,962.48
	合计	74,525,851.56	632,970.39	77,804,795.59	2,645,973.64
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		102,776,523.70	632,970.39	106,841,457.84	3,431,963.75
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		37,211,915.35	-	37,318,153.73	106,238.38
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	42,906,137.86	462,645.21	43,095,095.21	-273,687.86
	银行间市场	70,539,406.08	875,233.27	71,716,233.27	301,593.92
	合计	113,445,543.94	1,337,878.48	114,811,328.48	27,906.06
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		150,657,459.29	1,337,878.48	152,129,482.21	134,144.44

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末其他资产无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	29.10	179.65
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	36,285.70	74,830.13

其中：交易所市场	36,123.20	74,655.13
银行间市场	162.50	175.00
应付利息	-	-
预提费用	160,000.00	170,000.00
合计	196,314.80	245,009.78

7.4.7.7 实收基金

海富通安颐收益混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	94,224,250.59	94,224,250.59
本期申购	2,079,568.08	2,079,568.08
本期赎回（以“-”号填列）	-27,600,306.49	-27,600,306.49
本期末	68,703,512.18	68,703,512.18

海富通安颐收益混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,685,589.94	21,685,589.94
本期申购	768,225.31	768,225.31
本期赎回（以“-”号填列）	-8,482,179.16	-8,482,179.16
本期末	13,971,636.09	13,971,636.09

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

海富通安颐收益混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,462,748.91	7,183,630.10	20,646,379.01

本期期初	13,462,748.91	7,183,630.10	20,646,379.01
本期利润	2,301,036.62	2,707,435.43	5,008,472.05
本期基金份额交易产生的变动数	-3,755,288.49	-2,415,206.67	-6,170,495.16
其中：基金申购款	306,798.65	207,955.59	514,754.24
基金赎回款	-4,062,087.14	-2,623,162.26	-6,685,249.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,008,497.04	7,475,858.86	19,484,355.90

海富通安颐收益混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,546,650.19	1,681,906.84	5,228,557.03
本期期初	3,546,650.19	1,681,906.84	5,228,557.03
本期利润	460,395.74	590,383.88	1,050,779.62
本期基金份额交易产生的变动数	-1,286,177.93	-725,575.40	-2,011,753.33
其中：基金申购款	127,194.47	73,289.17	200,483.64
基金赎回款	-1,413,372.40	-798,864.57	-2,212,236.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,720,868.00	1,546,715.32	4,267,583.32

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
活期存款利息收入	15,436.26	18,985.75
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	82,975.17	148,853.38
其他	214.68	517.82
合计	98,626.11	168,356.95

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	219,825,777.51	185,536,185.83
减：卖出股票成本总额	219,079,399.76	189,718,446.64
减：交易费用	399,775.97	417,853.94
买卖股票差价收入	346,601.78	-4,600,114.75

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	2,629,032.71	3,642,208.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	493,679.82	219,403.38
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	3,122,712.53	3,861,612.09

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	101,911,310.63	185,995,489.75
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	99,698,256.10	183,276,316.34
减：应计利息总额	1,717,449.88	2,495,406.98
减：交易费用	1,924.83	4,363.05
买卖债券差价收入	493,679.82	219,403.38

7.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股指期货投资收益（税前）	263,700.00	700,440.00
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	8,074.95	23,819.99
减：交易费用	13,094.26	14,150.38
合计	242,530.79	662,469.63

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	796,039.08	969,039.12
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	796,039.08	969,039.12

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
1.交易性金融资产	3,297,819.31	2,224,510.56
——股票投资	679,751.73	1,520,114.02
——债券投资	2,618,067.58	704,396.54
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-

——其他	-	-
2.衍生工具	-	-22,160.00
——权证投资	-	-
——股指期货	-	-22,160.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	3,297,819.31	2,202,350.56

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
基金赎回费收入	5,653.98	21,730.28
基金转换费收入	212.92	44.53
合计	5,866.90	21,774.81

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
审计费用	40,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	9,111.96	13,804.10
债券托管账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他费用	1,200.00	1,200.00
合计	206,311.96	221,004.10

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日出具《关于同意国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司并募集配套资金注册、核准国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司、海富通基金管理有限公司变更主要股东及实际控制人、富国基金管理有限公司变更主要股东、海通期货股份有限公司变更主要股东及实际控制人的批复》（证监许可〔2025〕96 号）核准，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券所持海富通基金管理有限公司股权亦归属于合并后的国泰君安，即合并后的国泰君安成为海富通基金管理有限公司的主要股东，上海国际集团有限公司成为海富通基金管理有限公司实际控制人。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司 (“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
法国巴黎资产管理 BE 控股公司(BNP Paribas Asset Management BE Holding)	基金管理人的股东
上海富诚海富通资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	195,713,679.82	45.52%	29,122,913.27	8.24%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	90,364.18	34.45%	33,841.67	93.68%
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	21,006.75	8.70%	-	-

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金管理人提供的证券投资研究服务等。

2.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。公司的该类佣金协议符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	1,238,524.36	1,869,320.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	407,715.55	622,833.86
应支付基金管理人的净管理费	830,808.81	1,246,486.54

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为: 日管理人报酬＝前一日基金资产净值 x1.00%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	247,704.77	440,070.63

注:海富通安颐收益混合型证券投资基金的托管费率由 0.25%下调至 0.20%，自 2023 年 8 月 26 日起执行新的托管费率。

2023 年 8 月 26 日之前支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 x0.25%/当年天数。

2023 年 8 月 26 日之后（含）支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 x0.20%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通安颐收益混合A	海富通安颐收益混合C	合计
海通证券	-	24.57	24.57
海富通	-	21.62	21.62
合计	-	46.19	46.19
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通安颐收益混合A	海富通安颐收益混合C	合计
海通证券	-	6,206.00	6,206.00
海富通	-	5,897.02	5,897.02
合计	-	12,103.02	12,103.02

注：本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的基金销售服务费年费率为 0.10%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.10%年费率计提，逐日累计至每月月底,按月支付。销售服务费的计算方法如下：日销售服务费＝前一日 C 类份额的基金资产净值 x0.10%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C
报告期初持有的基金份额	14,780,873.55	-	14,780,873.55	-

报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	14,780,873.55	-	14,780,873.55	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	21.51%	-	15.69%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	4,577,019.08	15,436.26	3,432,439.45	18,985.75

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2024-12-23	重大事项	7.22	2025-01-07	6.93	7,600	51,447.00	54,872.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 6,999,546.33 元，于 2025 年 1 月 2 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制下跌风险的基础上，积极把握股票市场的投资机会，确保资产的保值增值，实现战胜绝对收益基准的目标，为投资者提供稳健的养老理财工具。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和督察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的三层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 34.42%（2023 年 12 月 31 日：54.45%）。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	5,873,277.04	7,539,066.30
合计	5,873,277.04	7,539,066.30

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级部分一般为国债、政策性金融债、央票、无第三方评级机构评级的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	9,962,108.31
合计	-	9,962,108.31

7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
AAA	23,957,741.05	62,102,238.74
AAA 以下	7,461,943.72	-
未评级	40,511,833.78	35,207,915.13
合计	71,931,518.55	97,310,153.87

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级部分一般为国债、政策性金融债、央票、无第三方评级机构评级的债券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 7.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均能及时变现。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发

行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有及承担的大部分权益类金融资产和金融负债不计息，该部分的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种存在相应的利率风险，基金

管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,577,019.08	-	-	-	4,577,019.08
结算备付金	2,533,647.63	-	-	-	2,533,647.63
存出保证金	11,955.18	-	-	-	11,955.18
交易性金融资产	10,982,267.73	31,522,808.33	35,299,719.53	29,036,662.25	106,841,457.84
应收清算款	-	-	-	44,015.19	44,015.19
应收申购款	-	-	-	36,238.01	36,238.01
资产总计	18,104,889.62	31,522,808.33	35,299,719.53	29,116,915.45	114,044,332.93
负债					
卖出回购金融资产款	6,999,546.33	-	-	-	6,999,546.33
应付清算款	-	-	-	907.35	907.35
应付赎回款	-	-	-	308,327.90	308,327.90
应付管理人报酬	-	-	-	91,407.35	91,407.35
应付托管费	-	-	-	18,281.46	18,281.46
应付销售服务费	-	-	-	1,570.53	1,570.53
应交税费	-	-	-	889.72	889.72
其他负债	-	-	-	196,314.80	196,314.80
负债总计	6,999,546.33	-	-	617,699.11	7,617,245.44
利率敏感度缺口	11,105,343.29	31,522,808.33	35,299,719.53	28,499,216.34	106,427,087.49
上年度末 2023 年 12 月 31 日	**1 年以内**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**
资产					
货币资金	3,432,439.45	-	-	-	3,432,439.45

结算备付金	7,355,366.93	-	-	-	7,355,366.93
存出保证金	11,151.92	-	-	-	11,151.92
交易性金融资产	68,129,032.04	37,091,913.34	9,590,383.10	37,318,153.73	152,129,482.21
应收清算款	-	-	-	31,442.08	31,442.08
应收申购款	-	-	-	44,183.98	44,183.98
资产总计	78,927,990.34	37,091,913.34	9,590,383.10	37,393,779.79	163,004,066.57
负债					
卖出回购金融资产款	19,597,677.37	-	-	-	19,597,677.37
应付清算款	-	-	-	783,821.50	783,821.50
应付赎回款	-	-	-	441,184.79	441,184.79
应付管理人报酬	-	-	-	121,812.85	121,812.85
应付托管费	-	-	-	24,362.57	24,362.57
应付销售服务费	-	-	-	2,303.28	2,303.28
应交税费	-	-	-	3,117.86	3,117.86
其他负债	-	-	-	245,009.78	245,009.78
负债总计	19,597,677.37	-	-	1,621,612.63	21,219,290.00
利率敏感度缺口	59,330,312.97	37,091,913.34	9,590,383.10	35,772,167.16	141,784,776.57

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-1,056,593.87	-732,895.04
	市场利率下降 25 个基点	1,082,914.34	745,634.22

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资及存托凭证 0%~95%，权证投资 0%~3%，债券、银行存款、货币市场工具、现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)及其它资产 5%~100%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	29,036,662.25	27.28	37,318,153.73	26.32
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	29,036,662.25	27.28	37,318,153.73	26.32

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

		本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
	1.业绩比较基准上升 5%	1,398,144.80	1,527,886.43
	2.业绩比较基准下降 5%	-1,398,144.80	-1,527,886.43

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	38,708,762.69	37,424,170.58
第二层次	68,132,695.15	114,705,311.63
第三层次	-	-
合计	106,841,457.84	152,129,482.21

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不会将相关股票和债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	764,401.39	764,401.39
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	918,207.88	918,207.88
当期利得或损失总额	-	153,806.49	153,806.49
其中：计入损益的利得或损失	-	153,806.49	153,806.49
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：于2024年12月31日，本基金未持有第三层次的交易性金融资产（2023年12月31日：

同）。于2024年度，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。(2023年度：从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资)。
计入损益的利得或损失计入利润表中的投资收益及公允价值变动损益项目。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2023 年 12 月 31 日：无）。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	29,036,662.25	25.46
	其中：股票	29,036,662.25	25.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	77,804,795.59	68.22
	其中：债券	77,804,795.59	68.22
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,110,666.71	6.24
8	其他各项资产	92,208.38	0.08

9	合计	114,044,332.93	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,372,956.00	1.29
C	制造业	18,409,277.65	17.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,778,802.00	1.67
E	建筑业	597,880.00	0.56
F	批发和零售业	434,911.00	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	589,104.00	0.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,411,371.64	1.33
J	金融业	3,238,475.60	3.04
K	房地产业	247,540.00	0.23
L	租赁和商务服务业	342,994.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	16,060.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	280,435.36	0.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	42,060.00	0.04
Q	卫生和社会工作	43,130.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	231,665.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	29,036,662.25	27.28

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	3,500	931,000.00	0.87
2	600900	长江电力	25,000	738,750.00	0.69
3	000333	美的集团	6,800	511,496.00	0.48
4	600066	宇通客车	19,100	503,858.00	0.47
5	601088	中国神华	10,900	473,932.00	0.45
6	000651	格力电器	10,400	472,680.00	0.44
7	601398	工商银行	65,900	456,028.00	0.43
8	600487	亨通光电	24,500	421,890.00	0.40
9	600522	中天科技	28,800	412,416.00	0.39
10	601668	中国建筑	58,100	348,600.00	0.33
11	600941	中国移动	2,900	342,664.00	0.32
12	002126	银轮股份	18,300	342,576.00	0.32
13	000400	许继电气	12,400	341,372.00	0.32
14	600642	申能股份	35,100	333,099.00	0.31
15	601077	渝农商行	52,700	318,835.00	0.30
16	002475	立讯精密	7,700	313,852.00	0.29
17	000997	新大陆	15,300	305,235.00	0.29
18	603283	赛腾股份	3,700	255,892.00	0.24
19	000100	TCL 科技	50,600	254,518.00	0.24
20	601225	陕西煤业	10,700	248,882.00	0.23
21	002966	苏州银行	30,400	246,544.00	0.23
22	000902	新洋丰	18,400	239,936.00	0.23
23	601577	长沙银行	26,400	234,696.00	0.22
24	601128	常熟银行	30,680	232,247.60	0.22
25	601665	齐鲁银行	39,900	223,041.00	0.21
26	002463	沪电股份	5,600	222,040.00	0.21
27	603129	春风动力	1,400	219,898.00	0.21
28	603855	华荣股份	10,500	213,045.00	0.20
29	600153	建发股份	19,800	208,296.00	0.20
30	605090	九丰能源	7,300	208,269.00	0.20
31	601717	郑煤机	15,700	203,786.00	0.19
32	300628	亿联网络	5,100	196,860.00	0.18
33	300979	华利集团	2,500	196,625.00	0.18
34	603871	嘉友国际	10,060	194,661.00	0.18
35	000425	徐工机械	24,500	194,285.00	0.18
36	600750	江中药业	8,200	186,140.00	0.17
37	688093	世华科技	8,927	180,236.13	0.17
38	600096	云天化	8,000	178,400.00	0.17
39	600710	苏美达	19,100	177,630.00	0.17

40	601000	唐山港	35,600	167,676.00	0.16
41	002483	润邦股份	32,000	166,720.00	0.16
42	600873	梅花生物	16,400	164,492.00	0.15
43	601169	北京银行	26,700	164,205.00	0.15
44	300502	新易盛	1,400	161,812.00	0.15
45	002311	海大集团	3,200	156,960.00	0.15
46	002371	北方华创	400	156,400.00	0.15
47	603296	华勤技术	2,200	156,090.00	0.15
48	688501	青达环保	11,109	155,859.27	0.15
49	600765	中航重机	7,300	149,431.00	0.14
50	002078	太阳纸业	10,000	148,700.00	0.14
51	601877	正泰电器	6,300	147,483.00	0.14
52	601658	邮储银行	25,600	145,408.00	0.14
53	300181	佐力药业	9,300	142,848.00	0.13
54	600131	国网信通	7,500	141,825.00	0.13
55	600601	方正科技	32,300	141,797.00	0.13
56	601138	工业富联	6,500	139,750.00	0.13
57	603766	隆鑫通用	15,100	137,410.00	0.13
58	000776	广发证券	8,400	136,164.00	0.13
59	601688	华泰证券	7,700	135,443.00	0.13
60	600664	哈药股份	32,000	132,160.00	0.12
61	600388	龙净环保	10,400	131,560.00	0.12
62	002532	天山铝业	16,700	131,429.00	0.12
63	600585	海螺水泥	5,400	128,412.00	0.12
64	300990	同飞股份	3,100	128,030.00	0.12
65	601058	赛轮轮胎	8,900	127,537.00	0.12
66	301004	嘉益股份	1,100	127,215.00	0.12
67	300888	稳健医疗	3,000	126,240.00	0.12
68	002422	科伦药业	4,200	125,706.00	0.12
69	002011	盾安环境	11,600	125,396.00	0.12
70	000807	云铝股份	9,200	124,476.00	0.12
71	605009	豪悦护理	3,100	123,876.00	0.12
72	600064	南京高科	15,800	122,766.00	0.12
73	601702	华峰铝业	6,700	122,744.00	0.12
74	603317	天味食品	9,200	122,728.00	0.12
75	601963	重庆银行	13,200	122,496.00	0.12
76	600497	驰宏锌锗	21,900	121,983.00	0.11
77	600036	招商银行	3,100	121,830.00	0.11
78	002241	歌尔股份	4,700	121,307.00	0.11
79	688408	中信博	1,676	120,672.00	0.11
80	603507	振江股份	4,900	117,796.00	0.11
81	300304	云意电气	14,400	115,200.00	0.11
82	603508	思维列控	4,800	114,144.00	0.11
83	603258	电魂网络	5,700	113,373.00	0.11

84	002531	天顺风能	14,300	113,113.00	0.11
85	603368	柳药集团	6,200	110,732.00	0.10
86	300433	蓝思科技	5,000	109,500.00	0.10
87	688376	美埃科技	3,276	109,385.64	0.10
88	002001	新和成	4,956	108,883.32	0.10
89	605507	国邦医药	5,200	108,316.00	0.10
90	002831	裕同科技	3,900	105,690.00	0.10
91	600887	伊利股份	3,500	105,630.00	0.10
92	300017	网宿科技	9,400	99,358.00	0.09
93	301345	涛涛车业	1,500	99,150.00	0.09
94	000513	丽珠集团	2,600	98,800.00	0.09
95	600566	济川药业	3,300	95,964.00	0.09
96	301305	朗坤环境	5,300	93,386.00	0.09
97	601001	晋控煤业	6,800	92,956.00	0.09
98	002832	比音勒芬	4,300	92,063.00	0.09
99	002139	拓邦股份	6,600	89,826.00	0.08
100	000885	城发环境	6,800	89,148.00	0.08
101	688330	宏力达	3,380	88,691.20	0.08
102	003000	劲仔食品	6,400	87,680.00	0.08
103	000719	中原传媒	7,700	87,472.00	0.08
104	603558	健盛集团	8,100	87,156.00	0.08
105	002541	鸿路钢构	4,800	86,064.00	0.08
106	600028	中国石化	12,600	84,168.00	0.08
107	301087	可孚医疗	2,360	83,449.60	0.08
108	688036	传音控股	867	82,365.00	0.08
109	600163	中闽能源	13,500	82,215.00	0.08
110	002752	昇兴股份	12,900	81,915.00	0.08
111	601998	中信银行	11,700	81,666.00	0.08
112	002353	杰瑞股份	2,200	81,378.00	0.08
113	600861	北京人力	4,200	81,270.00	0.08
114	688187	时代电气	1,682	80,601.44	0.08
115	000157	中联重科	11,100	80,253.00	0.08
116	300476	胜宏科技	1,900	79,971.00	0.08
117	601336	新华保险	1,600	79,520.00	0.07
118	605305	中际联合	2,800	79,324.00	0.07
119	600219	南山铝业	20,200	78,982.00	0.07
120	600098	广州发展	12,300	78,966.00	0.07
121	000848	承德露露	8,800	78,936.00	0.07
122	000001	平安银行	6,700	78,390.00	0.07
123	600027	华电国际	13,900	77,979.00	0.07
124	002142	宁波银行	3,200	77,792.00	0.07
125	300679	电连技术	1,300	77,610.00	0.07
126	600050	中国联通	14,600	77,526.00	0.07
127	603338	浙江鼎力	1,200	77,424.00	0.07

128	600998	九州通	15,100	77,312.00	0.07
129	002865	钧达股份	1,500	76,650.00	0.07
130	688480	赛恩斯	2,824	76,643.36	0.07
131	300926	博俊科技	3,415	75,164.15	0.07
132	601601	中国太保	2,200	74,976.00	0.07
133	002558	巨人网络	5,900	74,871.00	0.07
134	688016	心脉医疗	680	74,698.00	0.07
135	603606	东方电缆	1,400	73,570.00	0.07
136	300770	新媒股份	1,800	72,738.00	0.07
137	300482	万孚生物	3,200	71,712.00	0.07
138	000733	振华科技	1,700	71,689.00	0.07
139	603565	中谷物流	7,300	71,540.00	0.07
140	600795	国电电力	15,400	70,532.00	0.07
141	002180	纳思达	2,500	70,425.00	0.07
142	600266	城建发展	13,800	70,380.00	0.07
143	688361	中科飞测	799	69,952.45	0.07
144	300308	中际旭创	560	69,165.60	0.06
145	601825	沪农商行	7,900	67,229.00	0.06
146	601900	南方传媒	4,400	66,484.00	0.06
147	300408	三环集团	1,700	65,467.00	0.06
148	600499	科达制造	8,300	64,740.00	0.06
149	002517	恺英网络	4,600	62,606.00	0.06
150	601939	建设银行	6,900	60,651.00	0.06
151	600787	中储股份	9,500	60,610.00	0.06
152	603102	百合股份	1,700	59,670.00	0.06
153	002687	乔治白	13,200	57,816.00	0.05
154	600285	羚锐制药	2,600	57,616.00	0.05
155	300470	中密控股	1,500	56,550.00	0.05
156	600458	时代新材	4,400	56,364.00	0.05
157	600660	福耀玻璃	900	56,160.00	0.05
158	000090	天健集团	13,600	55,896.00	0.05
159	601857	中国石油	6,200	55,428.00	0.05
160	603055	台华新材	5,000	55,400.00	0.05
161	002252	上海莱士	7,600	54,872.00	0.05
162	002035	华帝股份	7,400	54,316.00	0.05
163	600894	广日股份	3,700	54,020.00	0.05
164	300360	炬华科技	3,200	53,664.00	0.05
165	002027	分众传媒	7,600	53,428.00	0.05
166	002947	恒铭达	1,600	53,328.00	0.05
167	603040	新坐标	2,300	52,716.00	0.05
168	600273	嘉化能源	6,600	52,602.00	0.05
169	002705	新宝股份	3,500	52,500.00	0.05
170	600248	陕建股份	11,700	52,416.00	0.05
171	000895	双汇发展	2,000	51,920.00	0.05

172	002318	久立特材	2,200	51,502.00	0.05
173	000498	山东路桥	8,600	51,170.00	0.05
174	601898	中煤能源	4,200	51,156.00	0.05
175	601666	平煤股份	5,100	51,102.00	0.05
176	605377	华旺科技	3,800	50,730.00	0.05
177	600985	淮北矿业	3,600	50,652.00	0.05
178	002130	沃尔核材	2,000	50,500.00	0.05
179	600348	华阳股份	7,100	50,339.00	0.05
180	002064	华峰化学	6,100	49,898.00	0.05
181	601916	浙商银行	17,100	49,761.00	0.05
182	603799	华友钴业	1,700	49,742.00	0.05
183	601919	中远海控	3,200	49,600.00	0.05
184	601528	瑞丰银行	8,800	49,544.00	0.05
185	002601	龙佰集团	2,800	49,476.00	0.05
186	688550	瑞联新材	1,576	49,313.04	0.05
187	002472	双环传动	1,600	48,992.00	0.05
188	600872	中炬高新	2,200	48,444.00	0.05
189	601168	西部矿业	3,000	48,210.00	0.05
190	688169	石头科技	218	47,805.22	0.04
191	688002	睿创微纳	1,014	47,668.14	0.04
192	300910	瑞丰新材	1,000	47,590.00	0.04
193	601311	骆驼股份	5,700	47,253.00	0.04
194	002533	金杯电工	4,800	47,232.00	0.04
195	603298	杭叉集团	2,640	47,229.60	0.04
196	002154	报喜鸟	10,700	47,187.00	0.04
197	000928	中钢国际	7,400	47,138.00	0.04
198	000682	东方电子	4,400	47,124.00	0.04
199	002543	万和电气	4,600	47,104.00	0.04
200	002128	电投能源	2,400	46,992.00	0.04
201	603341	龙旗科技	1,000	46,750.00	0.04
202	688210	统联精密	2,325	46,407.00	0.04
203	603173	福斯达	2,000	46,100.00	0.04
204	600422	昆药集团	2,900	45,965.00	0.04
205	002150	通润装备	3,700	45,880.00	0.04
206	600483	福能股份	4,600	45,862.00	0.04
207	603998	方盛制药	4,400	45,848.00	0.04
208	603529	爱玛科技	1,100	45,122.00	0.04
209	688123	聚辰股份	770	45,060.40	0.04
210	300740	水羊股份	3,400	44,948.00	0.04
211	301191	菲菱科思	500	44,725.00	0.04
212	600079	人福医药	1,900	44,422.00	0.04
213	601019	山东出版	3,900	44,265.00	0.04
214	688663	新风光	2,024	43,941.04	0.04
215	000603	盛达资源	3,600	43,164.00	0.04

216	300244	迪安诊断	3,800	43,130.00	0.04
217	601567	三星医疗	1,400	43,064.00	0.04
218	002487	大金重工	2,100	43,029.00	0.04
219	600970	中材国际	4,500	42,660.00	0.04
220	300453	三鑫医疗	5,700	42,522.00	0.04
221	300119	瑞普生物	2,300	42,251.00	0.04
222	000526	学大教育	1,000	42,060.00	0.04
223	601101	昊华能源	5,100	41,973.00	0.04
224	688019	安集科技	296	41,250.56	0.04
225	002223	鱼跃医疗	1,100	40,139.00	0.04
226	605319	无锡振华	1,900	39,995.00	0.04
227	002850	科达利	400	39,072.00	0.04
228	000933	神火股份	2,300	38,870.00	0.04
229	000543	皖能电力	4,900	38,759.00	0.04
230	600150	中国船舶	1,000	35,960.00	0.03
231	001308	康冠科技	1,300	35,750.00	0.03
232	000028	国药一致	1,200	35,100.00	0.03
233	688099	晶晨股份	498	34,202.64	0.03
234	603086	先达股份	7,900	33,812.00	0.03
235	300144	宋城演艺	3,600	33,444.00	0.03
236	003019	宸展光电	1,300	33,254.00	0.03
237	605333	沪光股份	1,000	32,630.00	0.03
238	603786	科博达	500	30,900.00	0.03
239	002756	永兴材料	800	30,176.00	0.03
240	300274	阳光电源	400	29,532.00	0.03
241	000921	海信家电	1,000	28,900.00	0.03
242	002911	佛燃能源	2,200	27,808.00	0.03
243	002801	微光股份	1,100	26,906.00	0.03
244	000429	粤高速 A	1,800	26,460.00	0.02
245	603699	纽威股份	1,100	24,387.00	0.02
246	301580	爱迪特	400	23,240.00	0.02
247	300264	佳创视讯	4,300	23,177.00	0.02
248	600649	城投控股	5,200	23,140.00	0.02
249	601009	南京银行	2,100	22,365.00	0.02
250	300820	英杰电气	400	22,100.00	0.02
251	300092	科新机电	1,900	21,926.00	0.02
252	300435	中泰股份	1,800	21,744.00	0.02
253	600323	瀚蓝环境	900	21,258.00	0.02
254	601838	成都银行	1,200	20,532.00	0.02
255	600926	杭州银行	1,400	20,454.00	0.02
256	300993	玉马遮阳	1,800	20,322.00	0.02
257	002043	兔宝宝	1,700	20,196.00	0.02
258	002697	红旗连锁	3,400	20,094.00	0.02
259	000915	华特达因	700	19,726.00	0.02

260	002895	川恒股份	800	19,680.00	0.02
261	600803	新奥股份	900	19,512.00	0.02
262	002991	甘源食品	200	18,704.00	0.02
263	600919	江苏银行	1,900	18,658.00	0.02
264	601126	四方股份	1,100	18,656.00	0.02
265	601156	东航物流	1,100	18,557.00	0.02
266	002003	伟星股份	1,300	18,421.00	0.02
267	603156	养元饮品	800	18,272.00	0.02
268	000786	北新建材	600	18,186.00	0.02
269	603393	新天然气	600	18,162.00	0.02
270	603279	景津装备	1,000	17,880.00	0.02
271	002372	伟星新材	1,400	17,682.00	0.02
272	688516	奥特维	400	17,324.00	0.02
273	301272	英华特	500	17,255.00	0.02
274	605368	蓝天燃气	1,500	17,145.00	0.02
275	002674	兴业科技	1,800	17,082.00	0.02
276	000937	冀中能源	2,700	17,064.00	0.02
277	600888	新疆众和	2,400	17,040.00	0.02
278	002100	天康生物	2,600	17,030.00	0.02
279	600971	恒源煤电	1,800	16,938.00	0.02
280	002833	弘亚数控	1,000	16,830.00	0.02
281	002315	焦点科技	400	16,672.00	0.02
282	002968	新大正	1,800	16,578.00	0.02
283	603866	桃李面包	2,500	16,500.00	0.02
284	301276	嘉曼服饰	800	16,280.00	0.02
285	603017	中衡设计	2,000	16,060.00	0.02
286	002032	苏泊尔	300	15,963.00	0.01
287	000822	山东海化	2,800	15,904.00	0.01
288	600761	安徽合力	900	15,885.00	0.01
289	603938	三孚股份	1,400	15,134.00	0.01
290	600007	中国国贸	600	14,676.00	0.01
291	600309	万华化学	200	14,270.00	0.01
292	300592	华凯易佰	700	9,996.00	0.01
293	603818	曲美家居	2,900	7,888.00	0.01
294	002563	森马服饰	700	4,914.00	0.00
295	301088	戎美股份	300	4,047.00	0.00
296	002434	万里扬	500	3,100.00	0.00
297	301301	川宁生物	200	2,372.00	0.00
298	688596	正帆科技	7	248.85	0.00

注：根据山东玉马遮阳科技股份有限公司于 2025 年 1 月 8 日发布的《关于变更证券简称的公告》，自 2025 年 1 月 9 日起，公司的证券简称由“玉马遮阳”变更为“玉马科技”，证券代码“300993”保持不变。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	2,188,840.00	1.54
2	000333	美的集团	2,170,423.00	1.53
3	600522	中天科技	2,145,489.00	1.51
4	300274	阳光电源	1,958,686.00	1.38
5	601088	中国神华	1,647,544.00	1.16
6	601077	渝农商行	1,530,711.00	1.08
7	600941	中国移动	1,524,583.00	1.08
8	600919	江苏银行	1,382,278.00	0.97
9	601398	工商银行	1,369,345.00	0.97
10	601138	工业富联	1,298,569.00	0.92
11	300750	宁德时代	1,269,874.00	0.90
12	603129	春风动力	1,256,651.00	0.89
13	000100	TCL 科技	1,251,071.00	0.88
14	601601	中国太保	1,183,359.00	0.83
15	601001	晋控煤业	1,163,668.00	0.82
16	600642	申能股份	1,162,500.00	0.82
17	000651	格力电器	1,140,183.00	0.80
18	300308	中际旭创	1,134,078.00	0.80
19	000921	海信家电	1,103,957.83	0.78
20	002452	长高电新	1,092,391.00	0.77

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300274	阳光电源	2,142,163.40	1.51
2	600900	长江电力	1,995,906.00	1.41
3	000333	美的集团	1,955,910.00	1.38
4	000921	海信家电	1,818,940.00	1.28
5	601138	工业富联	1,801,170.00	1.27
6	600919	江苏银行	1,736,863.00	1.22

7	600941	中国移动	1,667,785.50	1.18
8	601601	中国太保	1,556,232.00	1.10
9	600522	中天科技	1,544,882.00	1.09
10	601088	中国神华	1,517,058.00	1.07
11	002027	分众传媒	1,393,590.00	0.98
12	000034	神州数码	1,373,561.00	0.97
13	601001	晋控煤业	1,297,685.00	0.92
14	300502	新易盛	1,283,710.00	0.91
15	002463	沪电股份	1,257,707.00	0.89
16	002452	长高电新	1,242,629.00	0.88
17	601077	渝农商行	1,234,481.00	0.87
18	000338	潍柴动力	1,214,240.00	0.86
19	300130	新国都	1,214,070.00	0.86
20	002353	杰瑞股份	1,192,760.00	0.84

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	210,118,156.55
卖出股票的收入（成交）总额	219,825,777.51

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	29,919,673.28	28.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	27,837,044.93	26.16
	其中：政策性金融债	11,253,323.29	10.57
4	企业债券	5,108,990.69	4.80
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	5,212,114.25	4.90
7	可转债（可交换债）	9,726,972.44	9.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	77,804,795.59	73.11

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	210210	21 国开 10	100,000	11,253,323.29	10.57
2	2121062	21 北京农商二级	100,000	10,335,989.04	9.71
3	230012	23 附息国债 12	95,000	10,256,475.55	9.64
4	2128025	21 建设银行二级 01	60,000	6,247,732.60	5.87
5	019740	24 国债 09	58,000	5,873,277.04	5.52

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的股指期货投资将主要用于套期保值。在预期市场上涨时，可以通过买入股指期货作为股票替代，增加股票仓位，同时提高资金的利用效率；在预期市场下跌时，可以通过卖出股指期货对冲股市整体下跌的系统性风险，对投资组合的价值进行保护。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在本报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局北京监管局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	11,955.18
2	应收清算款	44,015.19
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	36,238.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	92,208.38

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	118031	天 23 转债	2,269,575.63	2.13
2	113052	兴业转债	2,265,028.72	2.13
3	123071	天能转债	921,077.80	0.87

4	118008	海优转债	877,314.32	0.82
5	127024	盈峰转债	705,285.73	0.66
6	113636	甬金转债	599,565.19	0.56
7	113653	永 22 转债	492,874.05	0.46
8	123113	仙乐转债	405,939.00	0.38
9	113644	艾迪转债	311,105.23	0.29
10	128121	宏川转债	305,307.94	0.29
11	127059	永东转 2	292,809.82	0.28
12	123174	精锻转债	179,285.04	0.17
13	123104	卫宁转债	101,803.97	0.10

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
海富通安颐收益混合 A	34,689	1,980.56	21,431,383.84	31.19%	47,272,128.34	68.81%
海富通安颐收益混合 C	6,928	2,016.69	668,733.90	4.79%	13,302,902.19	95.21%
合计	41,617	1,986.57	22,100,117.74	26.73%	60,575,030.53	73.27%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、C 级比例分母为各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例

基金管理人所有从业人员持有本基金	海富通安颐收益混合 A	718,057.13	1.0452%
	海富通安颐收益混合 C	37.99	0.0003%
	合计	718,095.12	0.8686%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	海富通安颐收益混合 A	50~100
	海富通安颐收益混合 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通安颐收益混合 A	50~100
	海富通安颐收益混合 C	0
	合计	50~100

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
杜晓海	公募基金	>100
	私募资产管理计划	0
	合计	>100

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C
基金合同生效日（2013 年 5 月 29 日）基金份额总额	850,399,612.86	-
本报告期期初基金份额总额	94,224,250.59	21,685,589.94
本报告期基金总申购份额	2,079,568.08	768,225.31
减：本报告期基金总赎回份额	27,600,306.49	8,482,179.16
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	68,703,512.18	13,971,636.09

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

2024 年 9 月 4 日，海富通基金管理有限公司发布公告，路颖女士自 2024 年 9 月 2 日起担任公司董事长，杨仓兵先生因退休不再担任公司董事长。

2024 年 12 月 11 日，海富通基金管理有限公司发布公告，周小波先生自 2024 年 12 月 9 日起担任公司副总经理。

基金托管人：

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内改聘毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金审计的会计师事务所，并依法履行了公告手续。报告期内本基金应支付给所聘任会计师事务所的报酬为 40,000.00 元，该审计机构已为本基金提供审计服务的连续年限为 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	195,713,679.82	45.52%	90,364.18	34.45%	-
天风证券	2	108,067,285.03	25.14%	80,610.03	30.73%	-
招商证券	2	99,369,481.27	23.11%	73,127.07	27.88%	-
中信证券	2	20,844,478.87	4.85%	15,449.94	5.89%	-
国金证券	1	5,614,648.07	1.31%	2,495.74	0.95%	-
国盛证券	2	290,321.00	0.07%	210.68	0.08%	-
国泰君安	2	44,040.00	0.01%	19.20	0.01%	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金退租渤海证券 1 个交易单元、太平洋证券 2 个交易单元、中信证券 2 个交易单元、上海证券 1 个交易单元、中信建投证券 2 个交易单元。

2、交易单元的选择标准：

基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司，租用其交易单元供本基金证券交易。

3、交易单元的选择程序：

（1）由牵头部门依据上述交易单元选择标准及公司内控制度要求，对候选券商开展尽职调查，综合评估其财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力。

（2）经评估，牵头部门将符合公司制度要求的券商相关材料提交督察长进行合规性审查，再提交基金管理人的总经理办公会审议。

（3）基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	60,918,470.56	74.00%	371,400,000.00	23.89%	-	-
天风证券	8,529,741.52	10.36%	821,550,000.00	52.85%	-	-
招商证券	5,736,338.22	6.97%	2,000,000.00	0.13%	-	-
中信证券	6,385,578.28	7.76%	237,150,000.00	15.25%	-	-
国金证券	752,042.30	0.91%	112,940,000.00	7.26%	-	-
国盛证券	-	-	9,600,000.00	0.62%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日

			期
1	海富通安颐收益混合型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-23
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-18
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国中金财富证券有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-07-25
4	海富通基金管理有限公司关于董事长变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-09-04
5	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增爱建证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-09-12
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-11-22
7	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-12-11
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-12-13

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基

金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 124 只公募基金。截至 2024 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1722 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联《上海证券报》颁发的“金基金•偏股混合型基金三年期奖”。2021 年 9 月，由《中国证券报》主办的第十八届“中国基金业金牛奖”揭晓，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

2022 年 7 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”。2022 年 8 月，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。2022 年 9 月，海富通荣获中国保险资产管理业协会颁发的“IAMAC 推介 2021 年度保险资产管理业最受欢迎投资业务合作机构——最具进取基金公司”。2022 年 11 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《上海证券报》颁发的“金基金·灵活配置型基金三年期奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

2023 年 3 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获上海证券交易所颁发的“上交所 2022 年度债券旗舰 ETF”。2023 年 6 月，海富通收益增长证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置型明星基金奖”。2023 年 8 月，海富通荣获《上海证券报》颁发的“上证·中国基金投教创新案例奖”。

2024 年 12 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“债券型 ETF 典型精品案例”。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准设立海富通安颐收益混合型证券投资基金的文件

(二)海富通安颐收益混合型证券投资基金基金合同

(三)海富通安颐收益混合型证券投资基金招募说明书

(四)海富通安颐收益混合型证券投资基金托管协议

(五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件

(六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

13.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇二五年三月三十一日